

Рецензия на выпускную  
квалификационную работу на тему

«Методы теоретико-игрового моделирования сырьевых рынков»,

Ильичёв Максим Владимирович

38.03.01 «Экономика»

1. Четкость постановки целей и задач исследования

Цели и задачи выпускной квалификационной работы сформулированы вполне чётко и понятно, их теоретическая актуальность и практическая значимость не вызывают сомнения.

2. Обоснованность структуры и логики исследования

Структура работы соответствует заявленной теме. Работа состоит из введения, заключения, трех глав, списка литературы (43 источника) и двух приложений.

В первой части работы проведен анализ динамики нефтяного рынка в период с 1973 года по текущее время, рассмотрены уже существующие модели конкурентных процессов на мировом рынке нефти. Во второй части рассмотрены теоретические аспекты применения методов теории кооперативных игр для моделирования конкуренции на нефтяном рынке (КИМКНР). В третьей части рассмотрены практические аспекты использования КИМКНР для 5 игроков (КИМКНР-5). Приведены основные достоинства и недостатки данной модели.

3. Наличие вклада автора в результаты исследования

Автором проделана большая самостоятельная работа по адаптации классических концепций решения кооперативных игр с трансферабельной полезностью применительно к конкурентным процессам на рынке нефти. Подход проиллюстрирован на примере 5 основных игроков (3 отдельных стран, ОПЕК и оставшихся стран как единого игрока).

4. Научная новизна и практическая значимость исследования

В выпускной квалификационной работе автором предложен оригинальный подход к моделированию процессов конкуренции и кооперации на международном рынке нефти. Предложенная модель отражает реальные экономические факторы, объясняющие большую часть динамического развития выбранного сырьевого рынка, а также договорённости, формирующиеся между его основными участниками.

5. Умение применять методологию и методики научного исследования

В работе автором продемонстрировано умение применять совокупность научных методов таких, как: статистические методы, методы проверки адекватности математических моделей, теоретико-игровые методы моделирования.

6. Актуальность используемых информационных источников

В представленной работе использованы современные инструментальные средства источники информации: Excel с самостоятельно написанными макросами на языке VBA для расчётов коэффициентов модели, оценки её адекватности и нахождения оптимальных решений в практической главе (глава 3). Работа опирается на актуальные статьи авторов в области теории кооперативных игр.

7. Достоинства работы

Работа может быть охарактеризована как самостоятельный авторский проект. В ходе её выполнения были изучены особенности формирования цен на рынке нефти, как частного представителя рынков сырья, методы теоретико-игрового моделирования и обозначены границы их применения.

8. Замечания и недостатки работы

Затруднено практическое применение в силу теоретического характера модели.

9. Вопросы для защиты

По каким критериям выбирались игроки?

Возможно ли использование модели в практических целях (прогнозы)?

10. Допуск к защите и оценка работы

Отмеченные недостатки не носят принципиального характера. Считаю, что выпускная квалификационная работа М.В. Ильичёва соответствует требованиям стандартов по данной образовательной программе, а её автор заслуживает оценки А (ОТЛИЧНО) при условии успешной и убедительной защиты.

Рецензент

Кандидат экономических наук,

Главный специалист отдела Управления активами и пассивами  
Дирекции Казначейство ПАО «Банк «Санкт-Петербург»



К.В. Светлов